

**海富通稳固收益债券型证券投资基金**  
**2019 年第 4 季度报告**  
**2019 年 12 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年一月二十一日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通稳固收益债券
基金主代码	519030
交易代码	519030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日
报告期末基金份额总额	539,358,169.94 份
投资目标	通过合理运用投资组合优化策略，力争实现基金收益随着时间增长的逐步提升。
投资策略	本基金的整体投资策略分为三个层次：第一层次，即资产配置策略，将以优化投资组合保险策略为核心，实现基金投资目标；第二层次，即债券投资策略，将采用自上而下的策略，以久期管理为核心；第三层次，即股票投资策略，包括新股申购策略和积极的精选个股策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险品种。其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 10 月 1 日-2019 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	1,524,270.68
2.本期利润	10,298,911.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0311
4.期末基金资产净值	616,965,224.70
5.期末基金份额净值	1.144

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.09%	0.13%	0.69%	0.01%	1.40%	0.12%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通稳固收益债券型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2010 年 11 月 23 日至 2019 年 12 月 31 日)



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通恒丰定开债券基金经理；海富通	2015-12-18	-	10 年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011 年 10 月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总

	<p>弘丰定开债券基金经理；海富通货币基金经理；海富通瑞利债券基金经理；海富通上交所短融债券基金经理；海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理；海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理；海富通上</p>			<p>监，现任固定收益投资副总监。2013 年 8 月起任海富通货币基金经理。2014 年 8 月至 2019 年 9 月兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014 年 11 月起兼任海富通上证可质押城投债 ETF（现为海富通上证城投债 ETF）基金经理。2015 年 12 月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 9 月兼任海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通一年定开债券基金经理。2016 年 7 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2016 年 8 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞丰一年定开债券（现为海富通瑞丰债券）基金经理。2016 年 8 月至 2017 年 11 月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016 年 11 月至 2019 年 10 月兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017 年 1 月起兼任海富通上证周期产业债 ETF 基金经理。2017 年 2 月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 6 月兼任海富通富源债券基金经理。2017 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 9 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 指数增强）</p>
--	--	--	--	--

	证城投债 ETF 基金经理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理；固定收益投资副总监。				基金经理。2017 年 7 月至 2019 年 9 月兼任海富通瑞福一年定开债券（现为海富通瑞福债券）、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017 年 7 月至 2018 年 12 月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018 年 10 月起兼任海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 基金经理。2018 年 11 月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019 年 1 月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。2019 年 11 月起兼任海富通上证 5 年期地方政府债 ETF 基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通创业板增强基金经	2018-04-09	-	19 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至

理;海富通量化前锋股票基金经理;海富通欣荣混合基金经理;海富通欣享混合基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通研究精选混合基金经理;量化投资部总监。				2019 年 10 月兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。
---	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，

没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、督察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019 年第四季度 A 股市场震荡走高，其中科技成长类、金融周期类行业表现更为突出。截至 2019 年 12 月 31 日，沪深 300 收于 4096.58 点，单四季度上涨 7.39%；中小板指收于 6632.68 点，上涨 10.59%；创业板指收于 1798.12 点，上涨 10.48%。

具体来看，10 月份沪深 300、中小板指、创业板指均小幅微涨，当月农林牧渔行业因猪价大涨、业绩突出而领涨，以银行、地产为代表的低估值蓝筹和以家电、医药和食品饮料为代表的消费白马因三季报业绩稳健向好而表现领先，强周期的周期品表现落后。11 月份沪深 300、中小板指、创业板指均小幅微跌，风格也出现了变化，以电子、新能源、传媒为代表的科技成长个股领涨大盘，建材、汽车、有色、钢铁等受益经济企稳预期也有突出表现，而泛消费领域的食品饮料、医药等个股出现滞涨甚至下跌，农林牧渔则在监管层加强猪禽等价格管控后显著回落。12 月份市场出现了较大幅度上涨，沪深 300、中小板指、创业板指单月涨幅分别为 7.00%、8.80%、8.00%，经济企稳迹象不断验证、中美贸易谈判阶段性达成一致、国内货币政策持续推动融资成本稳步下行，这些均推动市场的经济预期和风险偏好不断修复，受益于经济预期改善和资金利率下行的建材、地产、有色、化工、汽车等表现突出，受益于风险偏好提升的传媒、电子、通信、计算机、券商等也表现较好，而弹性相对较低的银行、医药、食品饮料等涨幅较小。

四季度，中信一级行业分类中，绝大部分行业录得上涨。其中，建材（21.69%）、家电（14.61%）、电子元器件（14.52%）、传媒（13.69%）、汽车（13.07%）排名前五，而煤炭（1.61%）、建筑（0.92%）、电力及公用事业（0.88%）、商贸零售（0.08%）、国防军工（-1.27%）排名落后。

本报告期,本基金适当增加了一些股票配置,力争在风险可控的基础上,跑赢市场。

展望下季度,本基金的投资思路为在控制风险的基础上,积极地捕捉市场的结构性机会,力争跑赢市场。本基金也将利用动态的仓位调整来控制回撤风险。

债券方面,2019 年四季度债市总体呈现震荡走势。虽然资金面对债市有所支撑,但经济数据的边际企稳、通胀预期的升温、中美贸易谈判的积极进展以及货币政策的放松节奏对债市形成一定扰动。具体来看,经济方面,四季度国内经济略显韧性,其中 1-11 月工业增加值、固定资产投资和社会消费品零售总额累计同比上涨 5.6%、5.2%和 8%,增幅较前三季度分别持平、收窄 0.2 和 0.2 个百分点;与此同时,10 月以来中美暂停加征新关税,并就第一阶段经贸协议文本达成一致,增强了市场对经济阶段性企稳的预期;通胀方面,快速上涨的猪价引发通胀预期升温,带动四季度 CPI 中枢大幅升至 4%以上;货币政策方面,国内政策放松节奏偏缓,央行于 11 月调降 MLF 利率 5BP,并跟随调降逆回购操作利率 5BP,调降节奏和幅度相对谨慎。但四季度流动性供应较为充裕,银行间债券质押式回购利率中枢落在 2.33%的低位,较三季度下行 15BP。由此,四季度长端利率低位震荡,10 年期国开债收益率累计小幅上行 4BP,而 1 年期国开债收益率累计大幅下行 23BP,收益率曲线明显走陡。信用债方面,四季度 3 年期以内的品种的信用利差压缩有所趋缓,而 5 年期中票的信用利差压缩幅度较大,同时中低等级信用债收益率下行幅度更大。主要原因可能是机构负债端成本下行缓慢,在短端高等级品种无法覆盖成本的情况下,被动地通过拉长久期和在风险可控的情况下下沉信用获取较高的票息。可转债方面,尽管四季度权益市场整体处于震荡区间,但转债市场呈单边上行态势,整体估值水平一路上扬至年内高点,四季度中证转债指数累计上涨 6.59%。

本基金在四季度根据组合规模情况配置信用债并调整利率债久期,积极参与波段机会。同时,本管理人四季度根据市场情况调整了可转债资产,以在控制波动的同时获取权益上涨收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通稳固收益净值增长率为 2.09%,同期业绩比较基准收益率为 0.69%,基金净值跑赢业绩比较基准 1.40 个百分点。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产
----	----	-------	--------

			的比例 (%)
1	权益投资	102,960,013.24	16.62
	其中：股票	102,960,013.24	16.62
2	固定收益投资	500,325,809.30	80.77
	其中：债券	500,325,809.30	80.77
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,036,476.84	1.46
7	其他资产	7,107,589.94	1.15
8	合计	619,429,889.32	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	159,488.00	0.03
B	采矿业	1,014,441.00	0.16
C	制造业	57,952,837.64	9.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,720.00	0.01
E	建筑业	859,200.00	0.14
F	批发和零售业	208,824.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	609,305.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,400,076.00	0.23
J	金融业	28,579,871.00	4.63

K	房地产业	11,543,103.00	1.87
L	租赁和商务服务业	214,644.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	65,549.60	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	10,450.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	308,504.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	102,960,013.24	16.69

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	119,600	7,843,368.00	1.27
2	600036	招商银行	199,200	7,485,936.00	1.21
3	601318	中国平安	82,400	7,041,904.00	1.14
4	601939	建设银行	968,700	7,003,701.00	1.14
5	000002	万科 A	193,800	6,236,484.00	1.01
6	601166	兴业银行	306,800	6,074,640.00	0.98
7	000568	泸州老窖	68,400	5,928,912.00	0.96
8	600048	保利地产	324,000	5,242,320.00	0.85
9	600887	伊利股份	165,900	5,132,946.00	0.83
10	000338	潍柴动力	309,100	4,908,508.00	0.80

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,502,100.00	0.57

2	央行票据	-	-
3	金融债券	248,362,292.80	40.26
	其中：政策性金融债	248,362,292.80	40.26
4	企业债券	66,237,400.00	10.74
5	企业短期融资券	30,028,000.00	4.87
6	中期票据	110,289,000.00	17.88
7	可转债（可交换债）	41,907,016.50	6.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	500,325,809.30	81.09

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	1,161,860	117,057,395.00	18.97
2	018009	国开 1803	534,330	58,060,297.80	9.41
3	190205	19 国开 05	500,000	49,260,000.00	7.98
4	101901572	19 北排水 MTN002	200,000	20,120,000.00	3.26
5	101901603	19 巨化 MTN002	200,000	20,070,000.00	3.25

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金合同，本基金暂未参与股指期货交易。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

**5.11 投资组合报告附注**

5.11.1报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	41,232.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,896,725.20
5	应收申购款	1,169,632.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,107,589.94

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128046	利尔转债	499,190.88	0.08
2	128048	张行转债	496,941.90	0.08
3	128034	江银转债	489,646.08	0.08
4	128045	机电转债	486,624.00	0.08
5	128019	久立转 2	281,719.64	0.05
6	113518	顾家转债	279,070.00	0.05
7	113522	旭升转债	272,436.00	0.04
8	110047	山鹰转债	271,555.20	0.04
9	113011	光大转债	270,512.20	0.04
10	113523	伟明转债	267,127.70	0.04
11	123002	国祯转债	266,399.20	0.04
12	110046	圆通转债	263,017.20	0.04
13	110043	无锡转债	259,980.50	0.04
14	127006	敖东转债	256,859.20	0.04
15	113504	艾华转债	256,846.20	0.04
16	113019	玲珑转债	255,538.80	0.04
17	113516	苏农转债	254,860.20	0.04
18	123009	星源转债	254,548.50	0.04
19	113508	新风转债	254,498.40	0.04
20	113013	国君转债	253,898.40	0.04
21	113525	台华转债	253,843.20	0.04
22	110034	九州转债	252,790.20	0.04
23	128065	雅化转债	251,373.30	0.04
24	113519	长久转债	251,062.00	0.04
25	128060	中装转债	250,926.00	0.04
26	132009	17 中油 EB	250,297.20	0.04
27	110048	福能转债	249,754.40	0.04
28	110045	海澜转债	248,773.00	0.04
29	110042	航电转债	247,033.80	0.04

30	128021	兄弟转债	246,381.80	0.04
31	110031	航信转债	246,322.20	0.04
32	113505	杭电转债	244,975.00	0.04
33	113008	电气转债	243,515.10	0.04
34	113534	鼎胜转债	242,264.00	0.04
35	128038	利欧转债	241,231.50	0.04
36	113515	高能转债	240,999.40	0.04
37	110038	济川转债	240,441.60	0.04
38	110050	佳都转债	240,122.00	0.04
39	113022	浙商转债	239,632.20	0.04
40	113533	参林转债	239,497.50	0.04
41	110041	蒙电转债	238,606.20	0.04
42	113020	桐昆转债	238,331.50	0.04
43	110051	中天转债	238,032.20	0.04
44	113017	吉视转债	237,616.20	0.04
45	128051	光华转债	235,977.00	0.04
46	110053	苏银转债	235,953.90	0.04
47	128016	雨虹转债	235,817.40	0.04
48	110055	伊力转债	235,731.60	0.04
49	127005	长证转债	235,593.60	0.04
50	128032	双环转债	235,525.12	0.04
51	128053	尚荣转债	235,409.20	0.04
52	123019	中来转债	235,190.10	0.04
53	128064	司尔转债	235,027.10	0.04
54	128055	长青转 2	234,565.50	0.04
55	110056	亨通转债	234,253.80	0.04
56	110033	国贸转债	234,171.60	0.04
57	113014	林洋转债	233,818.00	0.04
58	127012	招路转债	233,763.60	0.04
59	132005	15 国资 EB	233,723.00	0.04
60	128035	大族转债	233,682.60	0.04

61	110054	通威转债	233,485.80	0.04
62	113009	广汽转债	233,320.80	0.04
63	113021	中信转债	233,068.40	0.04
64	128033	迪龙转债	232,852.50	0.04
65	128018	时达转债	232,838.00	0.04
66	128067	一心转债	232,698.90	0.04
67	110057	现代转债	232,638.00	0.04
68	113531	百姓转债	232,609.30	0.04
69	128015	久其转债	232,247.60	0.04
70	128058	拓邦转债	231,946.40	0.04
71	128028	赣锋转债	231,771.80	0.04
72	128044	岭南转债	231,763.00	0.04
73	113012	骆驼转债	231,726.00	0.04
74	113517	曙光转债	231,621.00	0.04
75	113016	小康转债	231,555.40	0.04
76	128061	启明转债	231,427.50	0.04
77	123023	迪森转债	231,404.50	0.04
78	128029	太阳转债	231,281.80	0.04
79	123004	铁汉转债	231,221.30	0.04
80	123025	精测转债	230,920.20	0.04
81	113527	维格转债	230,719.20	0.04
82	113532	海环转债	230,540.80	0.04
83	127007	湖广转债	230,452.20	0.04
84	128010	顺昌转债	230,413.80	0.04
85	127008	特发转债	230,302.80	0.04
86	132014	18 中化 EB	229,971.90	0.04
87	132011	17 浙报 EB	229,908.00	0.04
88	128022	众信转债	229,840.50	0.04
89	132006	16 皖新 EB	229,835.00	0.04
90	110052	贵广转债	229,535.60	0.04
91	128037	岩土转债	229,392.20	0.04

92	132007	16 凤凰 EB	229,368.00	0.04
93	113509	新泉转债	229,257.30	0.04
94	132015	18 中油 EB	229,059.60	0.04
95	132013	17 宝武 EB	228,802.40	0.04
96	128025	特一转债	228,800.50	0.04
97	128059	视源转债	228,365.70	0.04
98	123022	长信转债	227,188.00	0.04
99	110044	广电转债	226,317.70	0.04
100	113530	大丰转债	225,880.00	0.04
101	123021	万信转 2	225,656.40	0.04
102	128041	盛路转债	224,365.60	0.04
103	123003	蓝思转债	222,146.40	0.04
104	113521	科森转债	220,413.60	0.04
105	128020	水晶转债	217,988.80	0.04
106	128017	金禾转债	183,989.82	0.03

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	83,065,352.27
本报告期基金总申购份额	493,122,494.68
减：本报告期基金总赎回份额	36,829,677.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	539,358,169.94

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/11/05-2019/11/05	16,240,381.38	-	-	16,240,381.38	3.01%
	2	2019/11/15-2019/12/31	-	120,000.00	-	120,000.00	22.25%
	3	2019/11/06-2019/11/14	-	78,368.82	-	78,368.82	14.53%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 74 只公募基金。截至 2019 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1114 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通稳固收益债券型证券投资基金的文件
- （二）海富通稳固收益债券型证券投资基金基金合同
- （三）海富通稳固收益债券型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通稳固收益债券型证券投资基金托管协议

(五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六) 报告期内海富通稳固收益债券型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

## 9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36-37 层本基金管理人办公地址。

## 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二〇年一月二十一日